

Paris, le 26 septembre 2013

Prix 2013 du meilleur mémoire de master de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative

Laurent Mignon, directeur général de Natixis, et Michel Crouhy, président de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative, ont remis le prix 2013 du meilleur mémoire de master à Jiatu Cai, Olivier Daviet et Jens Olov Michael Ronnqvist.

Le prix du meilleur mémoire de master

Ce prix récompense chaque année des travaux d'une qualité exceptionnelle sur des sujets complexes d'actualité pour les banques, les assureurs et les sociétés de gestion. Ces travaux nécessitent le recours aux techniques de la finance quantitative les plus évoluées.

« Comme chaque année, le comité scientifique de la Fondation a été impressionné par la qualité des mémoires soumis pour ce prix sur des thèmes très variés. C'est la première année où nous constatons un net déplacement de la recherche en finance quantitative vers des problématiques qui touchent à la réglementation et à la gestion des risques, en particulier du risque systémique », note Michel Crouhy.

Les lauréats

Le comité scientifique de la Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative a sélectionné cette année trois lauréats parmi les 12 mémoires qui ont été soumis pour le Prix du meilleur mémoire de master :

Jiatu Cai du master M2MO de l'Université Paris 7 pour son mémoire : « *Risque de Contrepartie et de Liquidité* », réalisé chez CA-CIB ;

Olivier Daviet du master MScF de l'Université de Genève pour son mémoire : « *Commodity Futures Contagion and Diversification Potential : An Empirical Study in the U.S. Market* » ;

Jens Olov Michael Ronnqvist du master MSc in Mathematics and Finance d'Imperial College pour son mémoire : « *Default Contagion in Financial Networks* ».

La Fondation d'entreprise Natixis pour la recherche quantitative a pour objet le financement des recherches et manifestations dans le domaine de la finance quantitative (finance des marchés, gestion des risques, économétrie, finance statistique, valorisation des produits dérivés complexes). Elle finance des bourses de thèse de doctorat et des travaux de recherche universitaire sur des thèmes en prise directe avec les préoccupations actuelles des institutions financières. Elle co-organise des conférences avec des institutions universitaires de premier plan et récompense des travaux de recherche réalisés dans le cadre de thèses et de mémoires de fin d'études.

Contacts presse :

Andrea Pucnik
+33 1 58 32 01 03

Joanne Morrow
+ 33 1 58 55 05 12

 Suivez-nous sur Twitter! @Natixis_com